长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛环球行业股票(QDII)
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26日
报告期末基金份额总额	48,716,536.12份
投资目标	本基金主要投资于全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选股模型精选个股,投资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时,本基金为全球股票型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的股票型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	高盛资产管理有限责任合伙	中国银行(香港)有限公司
注册地址		200 West Street, New York, NY 10282-2198	香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港皇后大道中2号长江集团中心68楼	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-199,068.85
2.本期利润	4,023,544.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0811
4.期末基金资产净值	50,628,732.49
5.期末基金份额净值	1.039

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2013年12月31日。

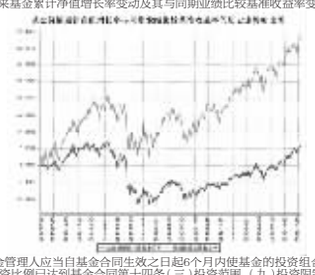
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.23%	0.49%	7.99%	0.58%	0.24%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴达	本基金基金经理,国际业务部总监,长盛基金(香港)有限公司副总经理。	2010年5月26日	-	11年	男,1979年8月出生,中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士,CFA(特许金融分析师)。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展曜硕全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资组合经理;新加坡华盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,现任国际业务部总监,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(本基金)基金经理,兼任长盛基金(香港)有限公司副总经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券从业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理,全球量化股票投资政策委员会成员。	20年	俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士,纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士,曾供职于史密斯.巴尼.希尔森公司。1994年加入高盛资产管理,曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析,并实施不同的交易策略。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

2013年第四季度,经济增长略超预期,通胀水平总体上有所上升,外汇占款持续增加。货币政策没有保经济增长下限的压力,继续维持了中性偏紧的总基调。随着市场利率中枢的上移,债券市场延续了熊市行情。具体来看:利率债方面,利率产品供需失衡加剧,一级市场招标利率屡创新高,并带动二级市场收益率快速上行,四季度10年期国债收益率上行约56bp,达到4.55%的高点,超过2011年的收益率高点约60BP。信用债方面,10月和11月份,受资金面偏紧以及年末债基赎回压力等因素影响,信用债发行利率不断上行,二级市场信用债加速下跌;12月份,随着信用利差的快速扩大,二级市场部分信用债收益率已上行至较高水平,安全边际有所增加,一级市场部分信用债推迟发行,信用债收益率下行速度有所放缓。

货币市场方面,四季度银行间资金面总体保持中性偏紧的态势,市场利率中枢有所上移,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均呈波动上升走势,以银行间七天回购利率为例,该利率在季四度总体基本在4.5%以上。

纯债资产以外,2013年四季度A股总体呈现震荡整理下行的态势。受正股震荡下行的行情带动,股性较强的转债在四季度总体呈现下跌走势,尤其是12月以来正股的大幅下跌导致转债快速下跌。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制配置节奏,投资品种以中短久期的中高等级信用债为主,提升组合流动性。密切关注高收益债券的信用风险暴露,严格控制其持仓比例,防控信用风险。同时,密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会,择机进行波段操作,有效提升组合收益。

2013年三季度,全球市场的投资交易主线围绕美联储货币政策会议及全球制造业季节性复苏展开,由于美联储没有对量化宽松做出改变,新兴市场包括金砖四国指数有所反弹,表现最好的是日本和亚太市场。美元汇率没有形成向上的趋势,在期间内回落到这几年的均值水平,缓解了资金回流美国的市场压力。反应在行业板块方面,年初以来表现最差的原材料和采矿业强劲反弹。

四季度美国经济指标继续改善,美联储宣布将从2014年1月份开始QE减量,并且只要就业形势继续改善、通胀不进一步下行,美联储将"可能在未来的会议上推出进一步的减量步骤"。但由于照顾到经济和劳动力市场的改善的可持续性,调整资产购买速度的步伐比较小,仅缩减一百亿,强调近期由于市场预期推动的按揭抵押利率上升对房地产市场的复苏有负面影响。

除美国外,欧洲经济继续保持见底回升缓慢复苏的态势,CPI增速小幅回升、PMI连续6个月扩张、制造业和服务业PMI指数双双突破50,回到扩张的景气水位上。国际资本开始对欧洲看好,逐渐开始回流欧洲市场。德国仍是欧元区经济增长的主要动力,反映了欧元区增长分化的情况仍将持续。然而,与发达地区相比,新兴市场国家普遍继续面临资金流出的压力。

由于财政政策的制约和货币政策的相对收缩,中国国内经济在年初经历了短暂的季节性反弹后重新进入缓慢下滑轨道,香港市场主板由于权重行业的拖累全年走低,中小市值的网络信息类、医药类股票全年表现大幅超越市场,进入2014年后这种分化行情有可能持续。

除德国和日本市场没有配置外,本基金全年维持对美国的重点配置,方向选择上偏重业绩表现良好的医疗保健、可选消费和科技信息板块,对于香港市场采取完全自下而上选股的方式,规避了市场的整体风险的同时取得了较好的回报。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.039元,本报告期份额净值增长率为8.23%,同期业绩比较基准增长率为7.99%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	42,378,897.58	82.66
	其中:普通股	37,694,515.17	73.52
	优先股	-	-
	存托凭证	2,968,909.85	5.79
	房地产信托凭证	1,715,472.56	3.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,442,348.61	12.57
8	其他资产	2,447,804.19	4.77
9	合计	51,269,050.38	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	32,409,864.48	64.01
香港	9,969,033.10	19.69

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
医疗	8,361,798.17	16.52
非必需消费品	7,606,037.70	15.02
信息技术	7,350,033.67	14.52
金融	7,095,605.52	14.01
工业	7,053,744.10	13.93
能源	2,013,651.12	3.98
必需消费品	1,791,147.29	3.54
材料	1,106,880.01	2.19
合计	42,378,897.58	83.71

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	PRICELINE.COM	-	PCLN US	纳斯达克证券交易所	美国	300	2,126,110.97	4.20
2	VISA INC-CLASS A SHA	-	V US	纽约证券交易所	美国	1,500	2,036,486.54	4.02
3	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,000	1,832,728.14	3.62
4	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	3,000	1,412,042.04	2.79
5	CHINA EVERBR INT	中国光大集团	257 HK	香港证券交易所	中国香港	170,000	1,387,381.46	2.74
6	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	4,000	1,364,486.22	2.70
7	QUALCOMM INC	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	3,000	1,358,084.48	2.68
8	CHINA STATE CONS	中国建筑国际	3311 HK	香港证券交易所	中国香港	122,000	1,333,288.83	2.63
9	BOEING CO	-	BA US	纽约证券交易所	美国	1,500	1,248,248.82	2.47
10	WUXI PHARMATECH INC-	-	WX US	纽约证券交易所	美国	5,300	1,240,194.82	2.45

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,387,591.58
3	应收股利	34,416.88
4	应收利息	309.72
5	应收申购款	25,486.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,447,804.19

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	48,966,969.88
报告期期间基金总申购份额	13,075,852.72
减:报告期期间基金总赎回份额	13,326,286.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	48,716,536.12

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2014年1月22日

长盛货币市场基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月12日
报告期末基金份额总额	6,981,165,736.14份
投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用,以提高投资决策的科学性与及时性,在控制风险的前提下,追求收益最大化。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1. 本期已实现收益	12,764,075.89
2.本期利润	12,764,075.89
3.期末基金资产净值	6,981,165,736.14

注:1、所列数据截止到2013年12月31日。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

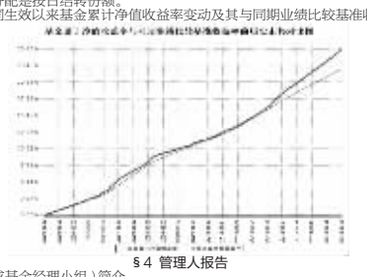
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1123%	0.0042%	0.7562%	0.0000%	0.3561%	0.0042%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾志敏	本基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2013年2月7日	-	7年	男,1982年3月出生,中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛货币市场基金(本基金)基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券从业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年第4季度,经济增长略超预期,通胀水平总体上有所上升,外汇占款持续增加。货币政策没有保经济增长下限的压力,继续维持了中性偏紧的总基调。随着市场利率中枢的上移,债券市场延续了熊市行情。具体来看:利率债方面,利率产品供需失衡加剧,一级市场招标利率屡创新高,并带动二级市场收益率快速上行,四季度10年期国债收益率上行约56bp,达到4.55%的高点,超过2011年的收益率高点约60BP。信用债方面,10月和11月份,受资金面偏紧以及年末债基赎回压力等因素影响,信用债发行利率不断上行,二级市场信用债加速下跌;12月份,随着信用利差的快速扩大,二级市场部分信用债收益率已上行至较高水平,安全边际有所增加,一级市场部分信用债推迟发行,信用债收益率下行速度有所放缓。

货币市场方面,四季度银行间资金面总体保持中性偏紧的态势,市场利率中枢有所上移,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均呈波动上升走势,以银行间七天回购利率为例,该利率在季四度总体基本在4.5%以上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,长盛季季红1年期债券A的基金份额净值为0.988元,本报告期份额净值增长率为-1.89%,同期业绩比较基准增长率为0.75%。

截止报告期末,长盛季季红1年期债券C的基金份额净值为0.987元,本报告期份额净值增长率为-1.89%,同期业绩比较基准增长率为0.75%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,850,545,950.94	85.24
	其中:债券	1,850,545,950.94	85.24
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	277,423,000.92	12.78
6	其他资产	43,134,961.15	1.99
7	合计	2,171,103,913.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	895,483,950.94	64.96
5	企业短期融资券	955,062,000.00	69.28
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,850,545,950.94	134.24

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年4季度,长盛货币净值收益率为1.1123%,同期业绩比较基准收益率0.7562%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	349,221,995.70	4.62
	其中:债券	349,221,995.70	4.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,903,553,060.33	25.17
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,189,314,593.15	55.39
4	其他资产	1,121,850,668.05	14.83
5	合计	7,563,940,317.23	100.00

注:本报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.73	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	11
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	11

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	86.34	8.31
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	2.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	1.00	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	0.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	92.28	8.31

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	189,215,029.66	2.71
	其中:政策性金融债	189,215,029.66	2.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	160,006,966.04	2.29
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	349,221,995.70	5.00
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130210	13国开10	900,000	89,860,730.75	1.29
2	130243	13国开43	400,000	39,689,201.87	0.57
3	041364003	13沁新能源CP001	300,000	30,001,830.35	0.43
4	041359035	13前进齿轮CP001	200,000	20,007,423.84	0.29
5	041359005	13广汇能源CP001	200,000	20,000,319.39	0.29
6	041354005	13京投CP001	200,000	20,000,169.44	0.29
7	041356020	13奇瑞CP001	200,000	20,000,065.15	0.29
8	041359012	13沙钢CP001	200,000	19,999,199.92	0.29
9	130236	13国开36	200,000	19,871,055.06	0.28
10	120409	12农发09	200,000	19,838,162.08	0.28

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1329%
报告期内偏离度的最低值	-0.0374%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0329%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	15,742,506.29
4	应收申购款	1,106,080,805.01
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,121,850,668.05

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	308,868,496.69
报告期期间基金总申购份额	8,170,914,355.52
减:报告期期间基金总赎回份额	1,498,617,116.07
报告期期末基金份额总额	6,981,165,736.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运